

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指 数证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国国际金融股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	56
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	建信 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	建信 MSCI
基金主代码	512180
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 19 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司
报告期末基金份额总额	188,048,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，本基金的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数(英文: MSCI China A Inclusion RMB Index)。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533 010-66228000	010-65051166
传真	010-66228001	010-65059873
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建外门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建外门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
邮政编码	100033	100004
法定代表人	孙志晨	沈如军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京西城区金融大街 27 号 投资广场 22-23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	29,703,539.90
本期利润	10,147,366.32
加权平均基金份额本期利润	0.0365
本期加权平均净值利润率	3.32%
本期基金份额净值增长率	6.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	35,453,203.22
期末可供分配基金份额利润	0.1885
期末基金资产净值	223,501,203.22
期末基金份额净值	1.1885
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	18.85%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.79%	0.84%	8.35%	0.86%	0.44%	-0.02%
过去三个月	15.47%	0.91%	14.49%	0.92%	0.98%	-0.01%
过去六个月	6.54%	1.50%	5.80%	1.53%	0.74%	-0.03%
过去一年	15.52%	1.20%	14.01%	1.22%	1.51%	-0.02%
自基金合同生效起至今	18.85%	1.31%	15.34%	1.35%	3.51%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信MSCI中国A股国际通ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、基础设施投资部、网络金融部、人力资源管理部、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资风险管理部、内控合规部和审计部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公司一建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家资产管理行业的领跑者”。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信富时 100 指数型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信灵活配置混

合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信短债债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金（LOF）、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证

券投资基金及其联接基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金，建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金共计 126 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4939.77 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理，本基金的基金经理	2018年4月19日	-	17年	梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理，博士。特许金融分析师（CFA）。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金（LOF）的基金经理；2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券

					<p>投资基金 (ETF) 及其联接基金的基金经理 2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数增强型证券投资基金的基金经理; 2015 年 3 月 25 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理, 该基金自 2020 年 5 月 7 日转型为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF), 梁洪昀继续担任该基金的基金经理; 2015 年 7 月 31 日至 2018 年 7 月 31 日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理; 2015 年 8 月 6 日至 2016 年 10 月 25 日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理 2018 年 2 月 6 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2018 年 6 月 13 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理; 2018 年 2 月 7 日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理; 2018 年 4 月 19 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2018 年 5 月 16 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注: ①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章, 依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产, 在认真控制投资风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益, 没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人, 保护投资人利益, 避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行

为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 2 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在报告期内，一直保持了高仓位，以满足上市运作要求以及跟踪误差控制要求。在报告期内，基金标的指数的成分股进行了两次调整，管理人据此对组合进行了相应调整。由于四舍五入取整等原因，基金申赎清单中股票的权重结构与标的指数成分股的权重之间存在一定差异，这会给基金组合对标的指数的跟踪造成一定误差。管理人通过对组合结构的适当调整，尽力降低了这些不利影响，跟踪误差和偏离度都保持在了较低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 6.54%，波动率 1.50%，业绩比较基准收益率 5.80%，波动率 1.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年，Covid-19 疫情对全球的经济和社会生活造成了很大冲击。经过艰苦努力，中国有效地控制了疫情在国内的传播，同时，适时推出多项宏观经济政策，尽力缓解实体经济受到的压力。预计下半年，疫情对投资者情绪造成的影响将会明显缓和，它对实体经济的实质影响会成为市场关注的重点。一些涉及国际经贸关系和政治关系的事件，亦可能成为中短期的扰动因素。A 股市场预计会在一个较宽的区间内运行，波动性比遭受事件冲击的上半年有所下降。本管理人将根

据基金合同，继续秉承被动复制策略，力争将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2017]13号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、投资风险管理部门和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）；对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,748,276.69	8,443,859.73
结算备付金		71,112.42	1,121,294.86
存出保证金		256,584.12	158,743.71
交易性金融资产	6.4.7.2	220,135,512.54	426,622,488.90
其中：股票投资		220,135,512.54	426,622,488.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		102,109.81	349,349.51

应收利息	6.4.7.5	2,482.69	6,829.26
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		227,316,078.27	436,702,565.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		236,335.83	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		94,346.06	190,774.24
应付托管费		18,869.21	38,154.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,258,184.41	3,197,177.60
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	207,139.54	427,332.51
负债合计		3,814,875.05	3,853,439.20
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	188,048,000.00	388,048,000.00
未分配利润	6.4.7.10	35,453,203.22	44,801,126.77
所有者权益合计		223,501,203.22	432,849,126.77
负债和所有者权益总计		227,316,078.27	436,702,565.97

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1885 元，基金份额总额 188,048,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		11,777,522.96	351,214,795.97

1. 利息收入		69,905.67	157,205.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	69,905.67	157,205.29
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		30,944,387.45	129,576,235.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	29,205,400.71	123,974,158.02
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,738,986.74	5,602,077.14
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-19,556,173.58	219,940,321.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	319,403.42	1,541,033.96
减：二、费用		1,630,156.64	4,980,520.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	764,015.44	2,518,485.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	152,803.11	503,697.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	535,274.91	1,439,281.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	178,063.18	519,056.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,147,366.32	346,234,275.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,147,366.32	346,234,275.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	388,048,000.00	44,801,126.77	432,849,126.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,147,366.32	10,147,366.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-200,000,000.00	-19,495,289.87	-219,495,289.87
其中：1. 基金申购款	114,000,000.00	8,536,871.14	122,536,871.14
2. 基金赎回款	-314,000,000.00	-28,032,161.01	-342,032,161.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	188,048,000.00	35,453,203.22	223,501,203.22
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,704,048,000.00	-317,212,285.66	1,386,835,714.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	346,234,275.62	346,234,275.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-1,070,000,000.00	-10,755,764.75	-1,080,755,764.75
其中：1. 基金申购款	592,000,000.00	-42,970,982.62	549,029,017.38
2. 基金赎回款	-1,662,000,000.00	32,215,217.87	-1,629,784,782.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益	634,048,000.00	18,266,225.21	652,314,225.21

(基金净值)			
--------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红	吴灵玲	丁颖
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]503 号《关于准予建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,046,048,000.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,046,048,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证自律监管决定书[2018]61 号审核同意,本基金于 2018 年 5 月 21 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股、国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执

行。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，对现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际通指数收益率 \times 95%+银行活期存款税后利率 \times 5%。本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司以本基金为目标 ETF，募集成立了建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“建信 MSCI 联接基金”）。建信 MSCI 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税

[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	6,748,276.69
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	6,748,276.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	193,543,371.14	220,135,512.54	26,592,141.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	193,543,371.14	220,135,512.54	26,592,141.40

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	2,335.19
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	32.00
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	115.50
合计	2,482.69

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,258,184.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,258,184.41

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付指数使用费	536.68
预提费用	206,602.86
合计	207,139.54

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	388,048,000.00	388,048,000.00
本期申购	114,000,000.00	114,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-314,000,000.00	-314,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	188,048,000.00	188,048,000.00

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	67,193,945.42	-22,392,818.65	44,801,126.77
本期利润	29,703,539.90	-19,556,173.58	10,147,366.32
本期基金份额交易产生的变动数	-44,608,604.66	25,113,314.79	-19,495,289.87
其中：基金申购款	25,503,695.34	-16,966,824.20	8,536,871.14
基金赎回款	-70,112,300.00	42,080,138.99	-28,032,161.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,288,880.66	-16,835,677.44	35,453,203.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	65,083.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,929.26
其他	1,892.58
合计	69,905.67

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	20,869,332.24
股票投资收益——赎回差价收入	8,336,068.47
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	29,205,400.71
----	---------------

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	197,880,337.22
减：卖出股票成本总额	177,011,004.98
买卖股票差价收入	20,869,332.24

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	342,032,161.01
减：现金支付赎回款总额	112,594,458.01
减：赎回股票成本总额	221,101,634.53
赎回差价收入	8,336,068.47

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,738,986.74
其中：证券出借权益补偿收	-

入	
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,738,986.74

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-19,556,173.58
股票投资	-19,556,173.58
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-19,556,173.58

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	319,403.42
合计	319,403.42

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	535,274.91
银行间市场交易费用	-
合计	535,274.91

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,345.87

指数使用费	86,209.71
合计	178,063.18

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司
建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“建信 MSCI 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
中金公司	231,017,707.20	69.54	691,917,990.43	80.06

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	215,149.39	69.87	3,229,525.64	99.12
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	644,385.26	80.40	2,799,364.75	95.53

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	764,015.44	2,518,485.27
其中：支付销售机构的客户维护费	66,682.98	219,070.85

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.50%/ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	152,803.11	503,697.07

注：支付基金托管人中金公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10%/ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)
建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	71,368,600.00	37.95	110,200,000.00	28.40

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 张)	总金额
中国国际金融股份有限公司	002946	新乳业	首次公开发行	3,823	20,835.35
中国国际金融股份有限公司	300762	上海瀚讯	首次公开发行	1,233	20,073.24
中国国际金融股份有限公司	603982	泉峰汽车	首次公开发行	1,845	18,062.55
中国国际金融股份有限公司	300782	卓胜微	首次公开发行	743	26,220.47

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股未上市	5.00	6.54	840	4,200.00	5,493.60	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新发未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新发未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新发未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新发未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新发未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制
上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、内
控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督
察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人
出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基
金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算
，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证
券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发
行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计
及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，
则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情

况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,748,276.69	-	-	-	6,748,276.69
结算备付金	71,112.42	-	-	-	71,112.42
存出保证金	256,584.12	-	-	-	256,584.12
交易性金融资产	-	-	-	-220,135,512.54	220,135,512.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	102,109.81	102,109.81
应收利息	-	-	-	2,482.69	2,482.69
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,075,973.23	-	-	-220,240,105.04	227,316,078.27
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	236,335.83	236,335.83
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	94,346.06	94,346.06
应付托管费	-	-	-	18,869.21	18,869.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,258,184.41	3,258,184.41
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	207,139.54	207,139.54
负债总计	-	-	-	3,814,875.05	3,814,875.05
利率敏感度缺口	7,075,973.23	-	-	-216,425,229.99	223,501,203.22
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,443,859.73	-	-	-	8,443,859.73
结算备付金	1,121,294.86	-	-	-	1,121,294.86
存出保证金	158,743.71	-	-	-	158,743.71
交易性金融资产	-	-	-	426,622,488.90	426,622,488.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	349,349.51	349,349.51
应收利息	-	-	-	6,829.26	6,829.26
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,723,898.30	-	-	-426,978,667.67	436,702,565.97
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	190,774.24	190,774.24
应付托管费	-	-	-	38,154.85	38,154.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,197,177.60	3,197,177.60
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	427,332.51	427,332.51
负债总计	-	-	3,853,439.20	3,853,439.20
利率敏感度缺口	9,723,898.30	-	-423,125,228.47	432,849,126.77

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
----	-------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	220,135,512.54	98.49	426,622,488.90	98.56
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	220,135,512.54	98.49	426,622,488.90	98.56

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2020年6月30日)	上年度末 (2019年12月31日)
分析	业绩比较基准上升 5%	10,941,396.25	21,368,563.50
	业绩比较基准下降 5%	-10,941,396.25	-21,368,563.50

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2020年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第

一层次的余额为人民币 220,096,643.83 元,属于第二层次的余额为人民币 36,515.72 元,属于第三层次的余额为人民币 0.00 元(于 2019 年 6 月 30 日,属于第一层次的余额为人民币 646,157,682.35 元,属于第二层次的余额为人民币 56,976.54 元,属于第三层次的余额为人民币 0.00 元)。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次,并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次,确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2 承诺事项

无。

6.4.14.3 其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	220,135,512.54	96.84
	其中:股票	220,135,512.54	96.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,819,389.11	3.00

8	其他各项资产	361,176.62	0.16
9	合计	227,316,078.27	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,443,404.00	1.54
B	采矿业	5,407,405.56	2.42
C	制造业	110,603,901.94	49.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,382,904.79	2.41
E	建筑业	4,493,859.48	2.01
F	批发和零售业	3,498,237.73	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	5,915,425.90	2.65
H	住宿和餐饮业	261,752.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,762,676.41	5.26
J	金融业	47,524,450.67	21.26
K	房地产业	7,927,616.70	3.55
L	租赁和商务服务业	3,000,835.58	1.34
M	科学研究和技术服务业	1,860,342.00	0.83
N	水利、环境和公共设施管理业	172,956.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	308,025.00	0.14
Q	卫生和社会工作	2,556,442.75	1.14
R	文化、体育和娱乐业	1,905,548.73	0.85
S	综合	141,655.00	0.06
	合计	216,167,440.24	96.72

注：合计项不含可退替代款的估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	3,534,451.02	1.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	185,977.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,904.61	0.03
J	金融业	166,620.36	0.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,965,719.31	1.77

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	8,696	12,721,204.48	5.69
2	601318	中国平安	75,278	5,374,849.20	2.40
3	600036	招商银行	142,182	4,794,377.04	2.15
4	000858	五粮液	25,507	4,364,757.84	1.95
5	600276	恒瑞医药	36,763	3,393,224.90	1.52
6	600900	长江电力	151,084	2,861,530.96	1.28
7	002475	立讯精密	48,332	2,481,848.20	1.11
8	300750	宁德时代	13,900	2,423,604.00	1.08
9	603288	海天味业	18,410	2,290,204.00	1.02

10	601166	兴业银行	142,700	2,251,806.00	1.01
11	600000	浦发银行	201,600	2,132,928.00	0.95
12	002714	牧原股份	24,054	1,972,428.00	0.88
13	300760	迈瑞医疗	6,200	1,895,340.00	0.85
14	601888	中国中免	12,286	1,892,412.58	0.85
15	002415	海康威视	61,032	1,852,321.20	0.83
16	601398	工商银行	369,098	1,838,108.04	0.82
17	601288	农业银行	509,200	1,721,096.00	0.77
18	600030	中信证券	69,400	1,673,234.00	0.75
19	000002	万科A	63,940	1,671,391.60	0.75
20	000001	平安银行	129,028	1,651,558.40	0.74
21	600585	海螺水泥	28,041	1,483,649.31	0.66
22	601668	中国建筑	290,312	1,384,788.24	0.62
23	601328	交通银行	268,575	1,377,789.75	0.62
24	600016	民生银行	242,824	1,376,812.08	0.62
25	603259	药明康德	14,080	1,360,128.00	0.61
26	600887	伊利股份	41,788	1,300,860.44	0.58
27	600048	保利地产	82,900	1,225,262.00	0.55
28	601601	中国太保	43,708	1,191,043.00	0.53
29	000661	长春高新	2,700	1,175,310.00	0.53
30	300015	爱尔眼科	26,300	1,142,735.00	0.51
31	000651	格力电器	20,100	1,137,057.00	0.51
32	600309	万华化学	21,900	1,094,781.00	0.49
33	300122	智飞生物	10,800	1,081,620.00	0.48
34	600031	三一重工	57,245	1,073,916.20	0.48
35	002352	顺丰控股	19,533	1,068,455.10	0.48
36	300059	东方财富	52,720	1,064,944.00	0.48
37	002304	洋河股份	10,088	1,060,652.32	0.47
38	002142	宁波银行	40,047	1,052,034.69	0.47
39	000725	京东方A	221,800	1,035,806.00	0.46
40	000063	中兴通讯	25,300	1,015,289.00	0.45
41	600588	用友网络	22,621	997,586.10	0.45
42	601688	华泰证券	52,800	992,640.00	0.44
43	601012	隆基股份	24,118	982,326.14	0.44
44	601818	光大银行	272,000	973,760.00	0.44
45	601766	中国中车	167,100	930,747.00	0.42
46	000568	泸州老窖	10,200	929,424.00	0.42
47	300498	温氏股份	41,920	913,856.00	0.41
48	600104	上汽集团	53,718	912,668.82	0.41
49	601211	国泰君安	52,600	907,876.00	0.41
50	002594	比亚迪	12,412	891,181.60	0.40
51	600050	中国联通	177,999	861,515.16	0.39

52	600999	招商证券	38,391	842,682.45	0.38
53	600809	山西汾酒	5,801	841,145.00	0.38
54	601988	中国银行	239,462	833,327.76	0.37
55	000876	新希望	27,900	831,420.00	0.37
56	600745	闻泰科技	6,600	831,270.00	0.37
57	603501	韦尔股份	4,100	827,995.00	0.37
58	000895	双汇发展	17,771	819,065.39	0.37
59	601229	上海银行	97,433	808,693.90	0.36
60	300413	芒果超媒	12,100	788,920.00	0.35
61	000538	云南白药	8,290	777,684.90	0.35
62	600570	恒生电子	7,140	768,978.00	0.34
63	600690	海尔智家	43,128	763,365.60	0.34
64	000166	申万宏源	148,742	751,147.10	0.34
65	001979	招商蛇口	45,363	745,767.72	0.33
66	603986	兆易创新	3,160	745,475.60	0.33
67	601066	中信建投	18,900	744,282.00	0.33
68	600837	海通证券	58,100	730,898.00	0.33
69	601006	大秦铁路	102,500	721,600.00	0.32
70	600703	三安光电	28,852	721,300.00	0.32
71	603160	汇顶科技	3,200	713,280.00	0.32
72	601169	北京银行	145,392	712,420.80	0.32
73	601390	中国中铁	140,400	704,808.00	0.32
74	600436	片仔癀	4,100	698,025.00	0.31
75	600028	中国石化	176,500	690,115.00	0.31
76	300601	康泰生物	4,243	688,044.88	0.31
77	601186	中国铁建	79,400	665,372.00	0.30
78	600406	国电南瑞	32,377	655,634.25	0.29
79	600547	山东黄金	17,680	647,441.60	0.29
80	601336	新华保险	14,608	646,842.24	0.29
81	002241	歌尔股份	21,900	642,984.00	0.29
82	601138	工业富联	41,800	633,270.00	0.28
83	601989	中国重工	155,700	622,800.00	0.28
84	601857	中国石油	148,300	621,377.00	0.28
85	002555	三七互娱	13,100	613,080.00	0.27
86	601933	永辉超市	65,300	612,514.00	0.27
87	000938	紫光股份	14,044	603,611.12	0.27
88	002007	华兰生物	11,820	592,300.20	0.27
89	601899	紫金矿业	134,138	590,207.20	0.26
90	600019	宝钢股份	127,900	583,224.00	0.26
91	002371	北方华创	3,400	581,094.00	0.26
92	600346	恒力石化	41,007	574,098.00	0.26
93	000776	广发证券	39,800	561,976.00	0.25

94	300014	亿纬锂能	11,696	559,653.60	0.25
95	000338	潍柴动力	40,300	552,916.00	0.25
96	601088	中国神华	38,391	551,294.76	0.25
97	000100	TCL 科技	88,600	549,320.00	0.25
98	002050	三花智控	24,800	543,120.00	0.24
99	002916	深南电路	3,240	542,764.80	0.24
100	300433	蓝思科技	19,300	541,172.00	0.24
101	002024	苏宁易购	61,500	539,355.00	0.24
102	300142	沃森生物	10,300	539,308.00	0.24
103	600015	华夏银行	88,100	539,172.00	0.24
104	601628	中国人寿	19,644	534,513.24	0.24
105	002027	分众传媒	95,900	534,163.00	0.24
106	002230	科大讯飞	13,950	522,148.50	0.23
107	601009	南京银行	69,300	507,969.00	0.23
108	002311	海大集团	10,600	504,454.00	0.23
109	601155	新城控股	15,900	496,716.00	0.22
110	002410	广联达	7,100	494,870.00	0.22
111	300033	同花顺	3,700	492,396.00	0.22
112	600009	上海机场	6,811	490,868.77	0.22
113	600340	华夏幸福	21,200	484,632.00	0.22
114	002624	完美世界	8,400	484,176.00	0.22
115	601100	恒立液压	6,000	481,200.00	0.22
116	600183	生益科技	16,100	471,247.00	0.21
117	600741	华域汽车	22,000	457,380.00	0.20
118	600196	复星医药	13,500	456,975.00	0.20
119	600438	通威股份	26,100	453,618.00	0.20
120	300124	汇川技术	11,799	448,244.01	0.20
121	600919	江苏银行	79,041	448,162.47	0.20
122	603993	洛阳钼业	122,100	448,107.00	0.20
123	002841	视源股份	4,500	447,840.00	0.20
124	300003	乐普医疗	12,100	441,892.00	0.20
125	600383	金地集团	31,600	432,920.00	0.19
126	601788	光大证券	26,727	429,235.62	0.19
127	300347	泰格医药	4,200	427,896.00	0.19
128	002271	东方雨虹	10,500	426,615.00	0.19
129	002602	世纪华通	27,600	422,556.00	0.19
130	002493	荣盛石化	34,350	422,505.00	0.19
131	601939	建设银行	66,323	418,498.13	0.19
132	601225	陕西煤业	57,500	414,575.00	0.19
133	002129	中环股份	18,300	411,018.00	0.18
134	300676	华大基因	2,600	405,366.00	0.18
135	600958	东方证券	42,590	404,179.10	0.18

136	601901	方正证券	57,000	403,560.00	0.18
137	002600	领益智造	37,600	399,688.00	0.18
138	002001	新和成	13,600	395,760.00	0.18
139	000596	古井贡酒	2,600	390,624.00	0.17
140	002120	韵达股份	15,880	388,266.00	0.17
141	601877	正泰电器	14,688	387,028.80	0.17
142	002236	大华股份	20,077	385,679.17	0.17
143	300558	贝达药业	2,700	377,946.00	0.17
144	000977	浪潮信息	9,620	376,911.60	0.17
145	300454	深信服	1,800	370,728.00	0.17
146	002460	赣锋锂业	6,887	368,936.59	0.17
147	601669	中国电建	106,600	368,836.00	0.17
148	600926	杭州银行	41,240	367,860.80	0.16
149	002044	美年健康	25,475	367,094.75	0.16
150	600886	国投电力	46,600	366,276.00	0.16
151	600600	青岛啤酒	4,775	365,287.50	0.16
152	601985	中国核电	89,300	365,237.00	0.16
153	002821	凯莱英	1,500	364,500.00	0.16
154	600893	航发动力	15,265	358,422.20	0.16
155	600763	通策医疗	2,100	350,217.00	0.16
156	600606	绿地控股	55,872	345,288.96	0.15
157	601881	中国银河	30,100	345,247.00	0.15
158	603019	中科曙光	8,960	344,064.00	0.15
159	603899	晨光文具	6,300	343,980.00	0.15
160	600010	宝钢股份	315,000	340,200.00	0.15
161	600845	宝信软件	5,700	336,756.00	0.15
162	300661	圣邦股份	1,100	335,555.00	0.15
163	002127	南极电商	15,800	334,486.00	0.15
164	603369	今世缘	8,400	334,236.00	0.15
165	601990	南京证券	23,420	334,203.40	0.15
166	300408	三环集团	11,900	329,630.00	0.15
167	600521	华海药业	9,690	328,781.70	0.15
168	600029	南方航空	63,565	328,631.05	0.15
169	002456	欧菲光	17,796	327,268.44	0.15
170	000069	华侨城 A	53,807	326,070.42	0.15
171	300253	卫宁健康	14,190	325,518.60	0.15
172	300529	健帆生物	4,670	324,565.00	0.15
173	002384	东山精密	10,800	323,460.00	0.14
174	000768	中航飞机	18,200	322,868.00	0.14
175	603939	益丰药房	3,520	320,320.00	0.14
176	300144	宋城演艺	18,483	319,755.90	0.14
177	600061	国投资本	25,000	318,250.00	0.14

178	300136	信维通信	6,000	318,120.00	0.14
179	600161	天坛生物	7,000	317,310.00	0.14
180	600872	中炬高新	5,400	316,062.00	0.14
181	600332	白云山	9,767	315,767.11	0.14
182	603659	璞泰来	3,000	309,060.00	0.14
183	603658	安图生物	1,900	308,636.00	0.14
184	002607	中公教育	11,100	308,025.00	0.14
185	601618	中国中冶	122,600	307,726.00	0.14
186	601377	兴业证券	44,640	305,784.00	0.14
187	002414	高德红外	10,440	305,683.20	0.14
188	601111	中国国航	46,100	304,721.00	0.14
189	002736	国信证券	26,900	303,970.00	0.14
190	002812	恩捷股份	4,600	302,680.00	0.14
191	000425	徐工机械	51,000	301,410.00	0.13
192	603799	华友钴业	7,702	299,299.72	0.13
193	002049	紫光国微	4,100	298,275.00	0.13
194	600660	福耀玻璃	14,100	294,267.00	0.13
195	000963	华东医药	11,601	293,505.30	0.13
196	002463	沪电股份	11,700	292,266.00	0.13
197	601360	三六零	15,952	292,081.12	0.13
198	600352	浙江龙盛	22,700	290,333.00	0.13
199	603517	绝味食品	4,100	290,034.00	0.13
200	601162	天风证券	47,400	287,244.00	0.13
201	000656	金科股份	34,900	284,784.00	0.13
202	002157	正邦科技	16,200	283,176.00	0.13
203	002179	中航光电	6,900	282,969.00	0.13
204	000157	中联重科	43,990	282,855.70	0.13
205	601727	上海电气	55,900	281,736.00	0.13
206	600674	川投能源	30,300	280,881.00	0.13
207	300595	欧普康视	4,050	280,827.00	0.13
208	000625	长安汽车	25,400	279,400.00	0.13
209	600536	中国软件	3,500	277,200.00	0.12
210	600115	东方航空	64,800	273,456.00	0.12
211	600298	安琪酵母	5,500	272,140.00	0.12
212	601872	招商轮船	46,600	271,678.00	0.12
213	002252	上海莱士	32,100	271,566.00	0.12
214	600018	上港集团	64,100	269,220.00	0.12
215	300383	光环新网	10,300	268,521.00	0.12
216	603882	金城医学	3,000	268,500.00	0.12
217	601319	中国人保	41,100	264,684.00	0.12
218	002065	东华软件	20,900	261,668.00	0.12
219	601108	财通证券	25,500	261,375.00	0.12

220	603707	健友股份	4,000	258,280.00	0.12
221	600760	中航沈飞	7,808	256,258.56	0.11
222	000066	中国长城	19,400	256,080.00	0.11
223	002032	苏泊尔	3,600	255,600.00	0.11
224	600085	同仁堂	9,400	254,928.00	0.11
225	603605	珀莱雅	1,400	252,028.00	0.11
226	300308	中际旭创	4,000	252,000.00	0.11
227	002385	大北农	27,600	251,436.00	0.11
228	600118	中国卫星	8,100	249,723.00	0.11
229	603338	浙江鼎力	3,280	248,525.60	0.11
230	600795	国电电力	134,100	248,085.00	0.11
231	600705	中航资本	62,600	247,896.00	0.11
232	601600	中国铝业	89,800	247,848.00	0.11
233	002185	华天科技	18,200	246,246.00	0.11
234	603444	吉比特	447	245,407.47	0.11
235	000786	北新建材	11,500	245,295.00	0.11
236	000783	长江证券	36,300	244,662.00	0.11
237	600109	国金证券	21,400	244,174.00	0.11
238	600522	中天科技	21,300	243,885.00	0.11
239	601607	上海医药	13,200	242,616.00	0.11
240	002690	美亚光电	4,600	241,960.00	0.11
241	601799	星宇股份	1,900	241,300.00	0.11
242	300450	先导智能	5,200	240,292.00	0.11
243	002603	以岭药业	7,700	240,163.00	0.11
244	601800	中国交建	32,636	239,548.24	0.11
245	600867	通化东宝	13,633	237,623.19	0.11
246	600498	烽火通信	8,200	237,062.00	0.11
247	600111	北方稀土	25,250	235,330.00	0.11
248	002373	千方科技	9,800	235,102.00	0.11
249	000860	顺鑫农业	4,100	233,618.00	0.10
250	600132	重庆啤酒	3,200	233,600.00	0.10
251	002146	荣盛发展	28,800	233,280.00	0.10
252	601919	中远海控	67,200	233,184.00	0.10
253	002299	圣农发展	8,000	232,000.00	0.10
254	600511	国药股份	5,700	231,819.00	0.10
255	600998	九州通	12,389	230,683.18	0.10
256	601021	春秋航空	6,500	229,060.00	0.10
257	300482	万孚生物	2,200	228,800.00	0.10
258	600637	东方明珠	23,591	227,653.15	0.10
259	600801	华新水泥	9,600	227,616.00	0.10
260	601555	东吴证券	27,890	227,582.40	0.10
261	002466	天齐锂业	9,788	224,634.60	0.10

262	002439	启明星辰	5,300	222,971.00	0.10
263	601231	环旭电子	10,200	222,768.00	0.10
264	600176	中国巨石	24,300	222,345.00	0.10
265	002223	鱼跃医疗	6,100	222,040.00	0.10
266	603858	步长制药	7,695	222,000.75	0.10
267	002202	金风科技	22,193	221,264.21	0.10
268	603833	欧派家居	1,897	219,862.30	0.10
269	600004	白云机场	14,400	219,456.00	0.10
270	002180	纳思达	6,658	219,114.78	0.10
271	300699	光威复材	3,480	218,300.40	0.10
272	300357	我武生物	3,500	217,875.00	0.10
273	000703	恒逸石化	23,780	217,111.40	0.10
274	601018	宁波港	60,700	216,699.00	0.10
275	600487	亨通光电	13,200	216,612.00	0.10
276	000021	深科技	9,900	216,117.00	0.10
277	600380	健康元	13,300	215,992.00	0.10
278	601198	东兴证券	19,700	214,730.00	0.10
279	603589	口子窖	4,200	213,780.00	0.10
280	300251	光线传媒	19,500	212,745.00	0.10
281	000961	中南建设	23,900	212,710.00	0.10
282	600779	水井坊	3,400	212,228.00	0.09
283	600201	生物股份	7,600	211,584.00	0.09
284	600011	华能国际	50,100	211,422.00	0.09
285	600271	航天信息	13,013	211,331.12	0.09
286	600489	中金黄金	23,100	211,134.00	0.09
287	002601	龙蟠佰利	11,400	210,900.00	0.09
288	002153	石基信息	5,400	210,762.00	0.09
289	600315	上海家化	4,400	210,760.00	0.09
290	002405	四维图新	12,700	209,423.00	0.09
291	300146	汤臣倍健	10,600	208,714.00	0.09
292	000975	银泰黄金	13,300	208,544.00	0.09
293	300316	晶盛机电	8,400	207,816.00	0.09
294	600895	张江高科	10,200	207,774.00	0.09
295	300212	易华录	3,700	207,200.00	0.09
296	600177	雅戈尔	34,600	206,216.00	0.09
297	001914	招商积余	6,700	205,891.00	0.09
298	600885	宏发股份	5,100	204,612.00	0.09
299	601689	拓普集团	7,300	203,670.00	0.09
300	600699	均胜电子	8,500	202,385.00	0.09
301	002152	广电运通	15,600	201,864.00	0.09
302	600739	辽宁成大	10,655	201,699.15	0.09
303	002739	万达电影	13,100	200,037.00	0.09

304	000728	国元证券	23,800	199,920.00	0.09
305	002558	巨人网络	11,480	199,752.00	0.09
306	002422	科伦药业	9,500	199,500.00	0.09
307	002212	南洋股份	7,500	199,350.00	0.09
308	300207	欣旺达	10,500	198,450.00	0.09
309	002773	康弘药业	4,000	198,400.00	0.09
310	600426	华鲁恒升	11,200	198,016.00	0.09
311	300285	国瓷材料	5,900	197,709.00	0.09
312	000050	深天马 A	12,801	196,623.36	0.09
313	601838	成都银行	24,700	196,612.00	0.09
314	002074	国轩高科	7,300	195,932.00	0.09
315	600655	豫园股份	22,100	195,806.00	0.09
316	603712	七一二	5,100	195,738.00	0.09
317	601998	中信银行	37,983	195,612.45	0.09
318	600642	申能股份	32,973	194,870.43	0.09
319	300496	中科创达	2,500	194,250.00	0.09
320	601878	浙商证券	19,600	194,236.00	0.09
321	603866	桃李面包	3,800	193,382.00	0.09
322	002294	信立泰	6,488	192,434.08	0.09
323	000513	丽珠集团	4,000	192,040.00	0.09
324	002511	中顺洁柔	8,600	191,780.00	0.09
325	002465	海格通信	14,804	191,563.76	0.09
326	600362	江西铜业	14,200	191,132.00	0.09
327	603883	老百姓	1,900	190,076.00	0.09
328	600170	上海建工	61,100	187,577.00	0.08
329	601117	中国化学	34,100	186,868.00	0.08
330	600068	葛洲坝	31,400	186,830.00	0.08
331	002156	通富微电	7,400	185,370.00	0.08
332	300418	昆仑万维	7,400	184,704.00	0.08
333	002673	西部证券	22,614	184,530.24	0.08
334	002557	洽洽食品	3,400	184,246.00	0.08
335	002019	亿帆医药	8,000	183,760.00	0.08
336	600066	宇通客车	15,000	183,000.00	0.08
337	002013	中航机电	23,100	182,490.00	0.08
338	600598	北大荒	11,300	181,930.00	0.08
339	002926	华西证券	17,100	181,773.00	0.08
340	600369	西南证券	39,600	181,764.00	0.08
341	002353	杰瑞股份	5,800	179,800.00	0.08
342	002925	盈趣科技	3,100	179,614.00	0.08
343	300088	长信科技	15,900	178,080.00	0.08
344	600208	新湖中宝	59,500	177,310.00	0.08
345	000739	普洛药业	7,600	177,004.00	0.08

346	601992	金隅集团	57,800	176,868.00	0.08
347	000723	美锦能源	28,200	176,532.00	0.08
348	002075	沙钢股份	14,100	176,250.00	0.08
349	600089	特变电工	25,944	175,640.88	0.08
350	000999	华润三九	6,000	175,140.00	0.08
351	600909	华安证券	25,539	174,431.37	0.08
352	002508	老板电器	5,595	174,060.45	0.08
353	600667	太极实业	14,700	173,754.00	0.08
354	600486	扬农化工	2,100	173,250.00	0.08
355	600221	海航控股	115,400	173,100.00	0.08
356	300070	碧水源	21,300	172,956.00	0.08
357	002131	利欧股份	44,700	172,542.00	0.08
358	600153	建发股份	21,211	171,809.10	0.08
359	600875	东方电气	19,201	169,928.85	0.08
360	601966	玲珑轮胎	8,400	169,680.00	0.08
361	002468	申通快递	10,300	169,023.00	0.08
362	600516	方大炭素	26,790	168,241.20	0.08
363	000671	阳光城	26,500	168,010.00	0.08
364	000627	天茂集团	32,200	167,762.00	0.08
365	300168	万达信息	7,600	167,732.00	0.08
366	601233	桐昆股份	12,900	164,604.00	0.07
367	600219	南山铝业	81,000	164,430.00	0.07
368	002242	九阳股份	4,400	163,988.00	0.07
369	002958	青农商行	36,900	163,467.00	0.07
370	002399	海普瑞	6,500	162,760.00	0.07
371	002507	涪陵榨菜	4,500	162,045.00	0.07
372	000423	东阿阿胶	4,517	161,753.77	0.07
373	002078	太阳纸业	16,900	160,888.00	0.07
374	600038	中直股份	3,900	160,173.00	0.07
375	002939	长城证券	13,000	160,160.00	0.07
376	600027	华电国际	46,700	159,714.00	0.07
377	600026	中远海能	24,400	157,624.00	0.07
378	300628	亿联网络	2,300	156,998.00	0.07
379	002797	第一创业	22,600	156,392.00	0.07
380	000750	国海证券	35,660	154,764.40	0.07
381	000988	华工科技	6,300	153,909.00	0.07
382	600754	锦江酒店	5,500	152,625.00	0.07
383	601099	太平洋	48,000	152,160.00	0.07
384	002340	格林美	30,600	152,082.00	0.07
385	002281	光迅科技	4,600	151,156.00	0.07
386	000540	中天金融	46,700	150,374.00	0.07
387	600188	兖州煤业	17,100	149,796.00	0.07

388	000547	航天发展	10,900	149,003.00	0.07
389	000932	华菱钢铁	39,400	148,538.00	0.07
390	601216	君正集团	58,200	147,828.00	0.07
391	600167	联美控股	10,300	147,702.00	0.07
392	600704	物产中大	34,800	146,508.00	0.07
393	600688	上海石化	41,854	145,651.92	0.07
394	300024	机器人	10,500	143,535.00	0.06
395	000998	隆平高科	8,600	143,190.00	0.06
396	002030	达安基因	5,220	142,401.60	0.06
397	600673	东阳光	20,500	141,655.00	0.06
398	000709	河钢股份	69,300	141,372.00	0.06
399	601128	常熟银行	18,800	141,188.00	0.06
400	000401	冀东水泥	8,800	141,152.00	0.06
401	600583	海油工程	30,700	139,685.00	0.06
402	002683	宏大爆破	4,000	139,600.00	0.06
403	600977	中国电影	10,631	139,585.03	0.06
404	002081	金螳螂	17,600	138,336.00	0.06
405	002174	游族网络	5,300	138,224.00	0.06
406	002396	星网锐捷	3,900	137,787.00	0.06
407	600566	济川药业	5,400	137,484.00	0.06
408	300271	华宇软件	4,800	135,408.00	0.06
409	002572	索菲亚	5,600	135,352.00	0.06
410	000688	国城矿业	7,300	135,269.00	0.06
411	600460	士兰微	9,200	135,056.00	0.06
412	600021	上海电力	18,100	133,940.00	0.06
413	300017	网宿科技	15,700	133,293.00	0.06
414	002387	维信诺	9,300	132,804.00	0.06
415	000630	铜陵有色	68,600	132,398.00	0.06
416	000402	金融街	19,900	132,136.00	0.06
417	600372	中航电子	9,900	131,868.00	0.06
418	600733	北汽蓝谷	20,400	131,172.00	0.06
419	601098	中南传媒	12,310	130,239.80	0.06
420	600160	巨化股份	18,900	130,221.00	0.06
421	000729	燕京啤酒	19,000	130,150.00	0.06
422	000825	太钢不锈	39,200	130,144.00	0.06
423	000686	东北证券	15,100	127,595.00	0.06
424	600256	广汇能源	46,200	124,740.00	0.06
425	002372	伟星新材	10,600	123,278.00	0.06
426	600820	隧道股份	21,800	123,170.00	0.06
427	000027	深圳能源	26,460	122,774.40	0.05
428	000028	国药一致	2,700	121,527.00	0.05
429	600879	航天电子	18,700	120,428.00	0.05

430	601699	潞安环能	21,600	120,312.00	0.05
431	000415	渤海租赁	40,300	120,094.00	0.05
432	002010	传化智联	22,000	119,680.00	0.05
433	000623	吉林敖东	7,500	117,975.00	0.05
434	600967	内蒙一机	11,300	117,407.00	0.05
435	000629	攀钢钒钛	57,400	115,374.00	0.05
436	600549	厦门钨业	9,700	114,848.00	0.05
437	600446	金证股份	5,900	114,460.00	0.05
438	600373	中文传媒	9,700	114,266.00	0.05
439	600675	中华企业	27,900	113,553.00	0.05
440	600466	蓝光发展	20,900	112,651.00	0.05
441	601958	金铂股份	18,100	111,858.00	0.05
442	300026	红日药业	20,000	110,400.00	0.05
443	002195	二三四五	39,126	109,944.06	0.05
444	002217	合力泰	20,900	109,725.00	0.05
445	600258	首旅酒店	7,100	109,127.00	0.05
446	000046	泛海控股	28,700	108,199.00	0.05
447	600808	马钢股份	41,580	107,276.40	0.05
448	002110	三钢闽光	15,800	105,228.00	0.05
449	600376	首开股份	17,900	104,894.00	0.05
450	002268	卫士通	4,900	104,566.00	0.05
451	000997	新大陆	6,500	103,870.00	0.05
452	000581	威孚高科	5,011	103,627.48	0.05
453	000983	西山煤电	27,560	103,350.00	0.05
454	603885	吉祥航空	11,300	102,830.00	0.05
455	600056	中国医药	7,200	101,880.00	0.05
456	600572	康恩贝	18,500	101,750.00	0.05
457	300296	利亚德	16,700	101,369.00	0.05
458	000883	湖北能源	28,700	101,024.00	0.05
459	000738	航发控制	7,400	101,010.00	0.05
460	601866	中远海发	54,600	100,464.00	0.04
461	002563	森马服饰	14,200	100,110.00	0.04
462	000089	深圳机场	12,900	98,814.00	0.04
463	601598	中国外运	30,426	98,275.98	0.04
464	600863	内蒙华电	39,800	97,908.00	0.04
465	000031	大悦城	18,900	96,201.00	0.04
466	000413	东旭光电	36,000	96,120.00	0.04
467	300012	华测检测	4,800	94,848.00	0.04
468	600260	凯乐科技	6,900	93,288.00	0.04
469	000598	兴蓉环境	19,900	91,540.00	0.04
470	002085	万丰奥威	13,900	90,072.00	0.04
471	002506	协鑫集成	33,300	86,913.00	0.04

472	000898	鞍钢股份	34,780	85,211.00	0.04
473	002500	山西证券	3,640	23,805.60	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	46,101	2,756,378.79	1.23
2	600297	广汇汽车	58,300	185,977.00	0.08
3	600535	天士力	10,900	176,798.00	0.08
4	601997	贵阳银行	23,271	166,620.36	0.07
5	600528	中铁工业	15,600	137,592.00	0.06
6	600398	海澜之家	21,197	123,366.54	0.06
7	002985	北摩高科	782	97,335.54	0.04
8	603087	甘李药业	774	77,632.20	0.03
9	002990	盛视科技	612	53,807.04	0.02
10	300837	浙矿股份	737	33,187.11	0.01
11	300828	锐新科技	977	28,430.70	0.01
12	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
13	300838	浙江力诺	909	22,243.23	0.01
14	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
15	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
16	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
17	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
18	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
19	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
20	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
21	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300760	迈瑞医疗	3,908,073.00	0.90
2	000661	长春高新	3,554,868.96	0.82
3	600519	贵州茅台	2,582,511.00	0.60
4	300750	宁德时代	2,221,045.62	0.51
5	000858	五粮液	2,209,862.00	0.51
6	002714	牧原股份	2,181,906.00	0.50
7	600745	闻泰科技	1,943,681.00	0.45
8	002916	深南电路	1,798,839.00	0.42
9	002415	海康威视	1,685,939.00	0.39
10	000001	平安银行	1,678,385.00	0.39

11	000002	万 科 A	1,603,212.00	0.37
12	300454	深信服	1,484,726.00	0.34
13	603986	兆易创新	1,429,071.70	0.33
14	002821	凯莱英	1,411,285.00	0.33
15	002475	立讯精密	1,371,485.33	0.32
16	603444	吉比特	1,366,224.00	0.32
17	603160	汇顶科技	1,358,416.88	0.31
18	000063	中兴通讯	1,221,825.00	0.28
19	002371	北方华创	1,125,659.00	0.26
20	000596	古井贡酒	1,072,947.00	0.25

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五 粮 液	6,417,863.81	1.48
2	000661	长春高新	5,395,018.00	1.25
3	300750	宁德时代	4,604,703.00	1.06
4	002415	海康威视	4,028,937.50	0.93
5	300760	迈瑞医疗	3,886,195.00	0.90
6	000002	万 科 A	3,827,798.00	0.88
7	000001	平安银行	3,438,809.00	0.79
8	002714	牧原股份	3,433,854.00	0.79
9	002475	立讯精密	3,149,982.00	0.73
10	002916	深南电路	2,277,062.00	0.53
11	000063	中兴通讯	2,276,281.00	0.53
12	000651	格力电器	2,243,204.00	0.52
13	300498	温氏股份	2,135,258.00	0.49
14	002821	凯莱英	2,025,288.00	0.47
15	300454	深信服	1,992,285.56	0.46
16	000725	京东方 A	1,978,896.00	0.46
17	001979	招商蛇口	1,923,107.00	0.44
18	002142	宁波银行	1,853,409.00	0.43
19	002304	洋河股份	1,848,959.86	0.43
20	300015	爱尔眼科	1,680,894.25	0.39

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	135,353,492.65
卖出股票收入（成交）总额	197,880,337.22

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），

不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	256,584.12
2	应收证券清算款	102,109.81
3	应收股利	-
4	应收利息	2,482.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	361,176.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
3,271	57,489.45	79,455,900.00	42.25	108,592,100.00	57.75

注：机构投资者包括建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	71,368,600.00	37.95

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中信证券股份有限公司	4,960,800.00	2.64
2	方正证券股份有限公司	2,003,900.00	1.07
3	黄继华	1,519,000.00	0.81
4	刘海涛	1,500,000.00	0.80
5	郭少华	1,096,000.00	0.58
6	徐国云	1,038,000.00	0.55
7	刘善荣	1,000,000.00	0.53
8	王锦华	1,000,000.00	0.53
9	张建军	1,000,000.00	0.53
10	娄立新	1,000,000.00	0.53
11	蒲巴甲	1,000,000.00	0.53
12	中国国际金融股份有限公司—建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金	71,368,600.00	37.95

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月19日） 基金份额总额	2,046,048,000.00
本报告期期初基金份额总额	388,048,000.00
本报告期基金总申购份额	114,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	314,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	188,048,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	4	231,017,707.20	69.54%	215,149.39	69.87%	-
长江证券	1	73,698,914.97	22.19%	67,163.59	21.81%	-
天风证券	1	27,482,895.58	8.27%	25,595.84	8.31%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人；

3、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于建信上证社会责任 ETF 等多只基金增加扩位证券简称的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-13
2	关于建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金和建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金修改调整结算模式的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-01-15

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2020 年 01 月 01 日 - 2020 年 06 月 30 日	110,200,000.00	8,000,000.00	46,831,400.00	71,368,600.00	37.95

注：本基金本报告期申购、赎回份额中包含了买入、卖出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2020 年 8 月 28 日